

附件 3

2023 年“期货投资分析”考试大纲

“期货投资分析”考试内容包括参考教材《期货及衍生品分析与应用》中的有关知识和应用,上述知识需要涉及“期货基础知识”考试中的知识。

第一章 宏观经济分析与指标

第一节 宏观经济分析框架

第二节 主要经济指标

第三节 货币金融指标

第二章 期货及衍生品定价

第一节 远期与期货定价

第二节 期权定价

第三节 期权中常见的希腊字母及波动率

第三章 统计与计量分析

第一节 统计分析

第二节 线性回归分析

第三节 时间序列分析

第四章 商品期货及衍生品分析与应用

第一节 商品期货价格影响因素

第二节 在实体企业中的应用

第三节 在资产配置中的应用

第四节 在促进农业发展中的应用

第五章 股指期货及衍生品分析与应用

第一节 分析方法

第二节 交易策略

第三节 产品开发与应用

第六章 国债期货及衍生品分析与应用

第一节 我国国债价格分析与供需格局

第二节 国债期货套期保值策略与应用

第三节 国债期货套利策略与应用

第四节 利率期权

第七章 外汇期货及衍生品分析与应用

第一节 影响汇率的因素

第二节 外汇远期与掉期交易

第三节 外汇期货与期权应用策略

第四节 汇率类衍生品在风险管理中的应用

第八章 场外衍生品

第一节 远期

第二节 互换

第三节 场外期权

第四节 信用衍生品

第九章 结构化产品

第一节 权益类结构化产品

第二节 利率类结构化产品

第三节 汇率类结构化产品

第十章 衍生品业务风险管理

第一节 风险识别

第二节 风险度量

第二节 风险对冲